

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2024
Fecha de Información: 26 de marzo de 2024¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2677 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.65%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	756,1	151,3	23,5	492,8	14,3	149,8	113,5
15-35	465,0	885,1	575,8	177,4	234,3	212,6	75,0
36-60	3,7	32,2	0,0	0,0	32,2	3,7	0,0
61-90	41,9	92,2	14,0	0,0	78,2	41,9	0,0
91-180	39,4	132,3	67,7	4,7	44,6	14,7	20,0
>180	136,3	150,4	115,4	126,8	35,0	9,6	0,0
Total	1442,4	1443,5	796,4	801,7	438,7	432,2	208,5

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.13%	6.57%	4.55%	4.88%
15-35	5.93%	6.03%	5.94%	6.00%
36-60	–	6.59%	5.63%	6.49%
61-90	–	6.10%	6.08%	6.09%
91-180	6.13%	6.14%	5.95%	6.10%
>180	–	5.77%	4.54%	5.51%
Total	6.06%	6.06%	5.11%	5.65%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	25 – 29 mar.				01 - 05 abr.				08 - 12 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	36	213	2937	2864	125	152	7567	8479	60	122	5072	5584
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1210	1244	0	0	4416	3567	0	0	3053	2283
Otros ^c	213	36	564	602	152	125	795	722	122	60	385	639
Total	249	249	4711	4710	277	277	12778	12768	182	182	8510	8506

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.